

富国天丰强化收益债券型证券投资基金

二〇二三年第 2 季度报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司

报告送出日期： 2023 年 07 月 21 日

§ 1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 富国天丰强化债券（LOF） |
| 场内简称 | 富国天丰 LOF（富国天丰） |
| 基金主代码 | 161010 |
| 交易代码 | 前端交易代码：161010 后端交易代码：161018 |
| 基金运作方式 | 契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。 |
| 基金合同生效日 | 2008年10月24日 |
| 报告期末基金份额总额 | 877,772,816.43份 |
| 投资目标 | 本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造较高的当期收益。 |
| 投资策略 | 本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会，发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种；另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险，从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。同时本基金也会采取相关策略投资附权债券、资产证券化产品、新股申购、存托凭证。 |
| 业绩比较基准 | 中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023年04月01日- 2023年06月30日） |
|-----------------|----------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 12,503,689.72 |
| 2. 本期利润 | 17,149,579.80 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0185 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,048,067,342.78 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.1940 |

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.61% | 0.19% | 1.67% | 0.04% | -0.06% | 0.15% |
| 过去六个月 | 3.46% | 0.19% | 2.64% | 0.04% | 0.82% | 0.15% |
| 过去一年 | 0.89% | 0.24% | 4.12% | 0.05% | -3.23% | 0.19% |
| 过去三年 | 19.99% | 0.26% | 12.12% | 0.05% | 7.87% | 0.21% |
| 过去五年 | 34.87% | 0.27% | 25.04% | 0.06% | 9.83% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 146.31% | 0.25% | 80.71% | 0.08% | 65.60% | 0.17% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2023 年 6 月 30 日。

2、本基金于 2008 年 10 月 24 日成立，建仓期 6 个月，从 2008 年 10 月 24 日起至 2009 年 4 月 23 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张明凯 | 本基金现任基金经理 | 2019-03-19 | — | 10 | 硕士，曾任南京银行信用研究员，鑫元基金管理有限公司研究员、基金经理；自2018年2月加入富国基金管理有限公司，自2018年5月起历任固定收益基金经理；现任富国基金固定收益投资部固定收益投资总监助理兼固定收益基金经理。自2019年03月起任富国可转换债券证券投资基金基金经理；自2019年03月起任富国收益增强债券型证券投资基金基金经理；自2019年03月起任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；自2022年04月起任富国利享回报12个月持有期混合型证券投资基金基金经理；具有基金从业资格。 |

注：1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天丰强化收益债券型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以为投资者减少和分散风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、

季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年上半年对经济基本面的预期出现了一定波动，从早期的极度乐观，修正为缓慢复苏，在长期矛盾和短期困境之间，管理层更注重建立长效机制，高质量发展仍然被放置在首要的位置。回首总结，对于经济的判断存在一定节奏上的失误，两年左右的基本面增长被压制，期待在重要事件突破后会出现井喷式的修复，但事实情况是经济在短暂的消费复苏后就进入到平缓期。疫后余波仍然存在，特别对投资的延续性构成较大压力，修复信心可能需要的时间更长。映射到上半年的资本市场，形成的结果就是债券利率先扬后抑，权益指数震荡分化。在这一过程中，组合更偏重确定性，特别对于所投资标的年内业绩的可测性有更高的要求，此外，估值水平也是较为看重的，板块之间的相对性价比是组合配置的核心理念。新能源、医药、军工、食品等方向正是基于这一理念来布局的。从结果来看，由于基本面修复的程度不及预期，市场对未来企业盈利分子的持续性也存在一定怀疑，导致景气度投资上半年出现失效。当然，公募基金流动性压力也是另外一层压制因素，上半年公募基金与非公募基金持仓存在较大的业绩差，客观上也造成了景气度投资失效的原因之一。

但展望后续，我们认为经济的增长仍然可期。一是源于经济自身动能的延续，生产逐步恢复叠加库存周期见底，有望带来下半年形成较为强劲的内生动能；二是政策端在二季度已经开始逐步发力，总量政策与产业结构性政策频出，量变到质变将只是时间问题；三是海外经济仍然超预期，且美联储加息预期将最终落地，美元指数顶部可能在下半年被确认，这将有助于全球风险偏好的再度提升。在这样的背景下，此时市场的悲观预期可能是过度了，权益定价处于历史较低水平，且大幅低于内生增长动能可能也是有失偏颇的。

组合上半年先采取了部分减仓，后续又逐步提升权益风险暴露，总体上对于未来经济增长仍保有较为乐观的预期，市场此前对于企业端盈利的担忧可能在月度数据发布后逐渐消退，届时优质企业，以及中期被市场低估的企业，可能存在较好的超额回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，本基金份额净值增长率为 1.61%，同期业绩比较基准收益率为 1.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | — | — |
| | 其中：股票 | — | — |
| 2 | 固定收益投资 | 1,096,333,744.53 | 92.48 |
| | 其中：债券 | 1,096,333,744.53 | 92.48 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 89,018,539.87 | 7.51 |
| 7 | 其他资产 | 191,403.66 | 0.02 |
| 8 | 合计 | 1,185,543,688.06 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有境内股票资产。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票资产。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 232,810,202.32 | 22.21 |
| | 其中：政策性金融债 | 60,691,437.93 | 5.79 |
| 4 | 企业债券 | 242,733,985.22 | 23.16 |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |
| 6 | 中期票据 | 45,782,403.66 | 4.37 |

| | | | |
|----|-----------|------------------|--------|
| 7 | 可转债（可交换债） | 575,007,153.33 | 54.86 |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 1,096,333,744.53 | 104.61 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 127947 | 21 铁道 08 | 1,000,000 | 104,175,835.62 | 9.94 |
| 2 | 185212 | 22 国君 C1 | 1,000,000 | 101,407,808.22 | 9.68 |
| 3 | 113056 | 重银转债 | 451,620 | 45,693,859.88 | 4.36 |
| 4 | 185644 | 22 华宝 01 | 420,000 | 42,433,359.45 | 4.05 |
| 5 | 118034 | 晶能转债 | 250,000 | 31,715,390.41 | 3.03 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国泰君安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行上海分行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。基金管理人将密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

本基金持有的其余证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 77,430.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | — |
| 5 | 应收申购款 | 113,973.11 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 其他 | — |
| 8 | 合计 | 191,403.66 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|---------|--------------|
|----|------|------|---------|--------------|

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 1 | 113056 | 重银转债 | 45,693,859.88 | 4.36 |
| 2 | 113065 | 齐鲁转债 | 20,962,470.87 | 2.00 |
| 3 | 127049 | 希望转2 | 18,912,718.90 | 1.80 |
| 4 | 132018 | G三峡EB1 | 14,186,095.89 | 1.35 |
| 5 | 110090 | 爱迪转债 | 13,943,292.47 | 1.33 |
| 6 | 118022 | 锂科转债 | 13,356,351.78 | 1.27 |
| 7 | 123067 | 斯莱转债 | 12,735,397.95 | 1.22 |
| 8 | 127066 | 科利转债 | 12,264,111.77 | 1.17 |
| 9 | 113582 | 火炬转债 | 11,850,828.56 | 1.13 |
| 10 | 118008 | 海优转债 | 11,477,781.03 | 1.10 |
| 11 | 127065 | 瑞鹄转债 | 10,947,827.05 | 1.04 |
| 12 | 111007 | 永和转债 | 10,794,200.96 | 1.03 |
| 13 | 123150 | 九强转债 | 10,522,313.56 | 1.00 |
| 14 | 123162 | 东杰转债 | 10,415,579.88 | 0.99 |
| 15 | 110075 | 南航转债 | 10,010,448.22 | 0.96 |
| 16 | 127069 | 小熊转债 | 9,819,100.82 | 0.94 |
| 17 | 127073 | 天赐转债 | 9,747,441.97 | 0.93 |
| 18 | 123158 | 宙邦转债 | 9,718,295.62 | 0.93 |
| 19 | 113648 | 巨星转债 | 9,717,267.67 | 0.93 |
| 20 | 127028 | 英特转债 | 9,222,356.16 | 0.88 |
| 21 | 113663 | 新化转债 | 8,389,282.19 | 0.80 |
| 22 | 127020 | 中金转债 | 7,603,500.82 | 0.73 |
| 23 | 113063 | 赛轮转债 | 6,880,370.24 | 0.66 |
| 24 | 128034 | 江银转债 | 6,529,527.12 | 0.62 |
| 25 | 113060 | 浙22转债 | 6,047,745.21 | 0.58 |
| 26 | 113629 | 泉峰转债 | 5,838,068.49 | 0.56 |
| 27 | 123156 | 博汇转债 | 5,804,865.76 | 0.55 |
| 28 | 123168 | 惠云转债 | 5,786,078.81 | 0.55 |
| 29 | 113653 | 永22转债 | 5,693,793.52 | 0.54 |
| 30 | 111009 | 盛泰转债 | 5,621,758.90 | 0.54 |
| 31 | 127043 | 川恒转债 | 5,337,611.60 | 0.51 |
| 32 | 118024 | 冠宇转债 | 5,332,247.26 | 0.51 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 33 | 123131 | 奥飞转债 | 5,300,087.67 | 0.51 |
| 34 | 123167 | 商络转债 | 5,258,688.56 | 0.50 |
| 35 | 123107 | 温氏转债 | 5,023,841.10 | 0.48 |
| 36 | 123075 | 贝斯转债 | 4,708,146.58 | 0.45 |
| 37 | 110074 | 精达转债 | 4,639,885.89 | 0.44 |
| 38 | 110088 | 淮22转债 | 4,639,884.93 | 0.44 |
| 39 | 127026 | 超声转债 | 4,516,023.10 | 0.43 |
| 40 | 123050 | 聚飞转债 | 4,512,716.31 | 0.43 |
| 41 | 128142 | 新乳转债 | 4,432,503.70 | 0.42 |
| 42 | 127036 | 三花转债 | 4,386,199.22 | 0.42 |
| 43 | 113054 | 绿动转债 | 4,127,938.63 | 0.39 |
| 44 | 127017 | 万青转债 | 4,072,948.86 | 0.39 |
| 45 | 123119 | 康泰转2 | 4,047,913.01 | 0.39 |
| 46 | 113654 | 永02转债 | 4,014,229.32 | 0.38 |
| 47 | 110085 | 通22转债 | 3,693,640.27 | 0.35 |
| 48 | 113047 | 旗滨转债 | 3,653,074.52 | 0.35 |
| 49 | 127016 | 鲁泰转债 | 3,650,332.05 | 0.35 |
| 50 | 113661 | 福22转债 | 3,631,406.30 | 0.35 |
| 51 | 110068 | 龙净转债 | 3,602,622.77 | 0.34 |
| 52 | 113594 | 淳中转债 | 3,504,853.40 | 0.33 |
| 53 | 113618 | 美诺转债 | 3,499,534.79 | 0.33 |
| 54 | 113059 | 福莱转债 | 3,357,648.77 | 0.32 |
| 55 | 110091 | 合力转债 | 2,904,862.84 | 0.28 |
| 56 | 113664 | 大元转债 | 2,897,247.12 | 0.28 |
| 57 | 113545 | 金能转债 | 2,759,875.07 | 0.26 |
| 58 | 127052 | 西子转债 | 2,643,111.44 | 0.25 |
| 59 | 127071 | 天箭转债 | 2,640,544.11 | 0.25 |
| 60 | 128109 | 楚江转债 | 2,621,245.07 | 0.25 |
| 61 | 113534 | 鼎胜转债 | 2,554,674.52 | 0.24 |
| 62 | 123172 | 漱玉转债 | 2,541,403.84 | 0.24 |
| 63 | 118023 | 广大转债 | 2,500,432.33 | 0.24 |
| 64 | 127006 | 敖东转债 | 2,448,243.84 | 0.23 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 65 | 123154 | 火星转债 | 2,396,539.73 | 0.23 |
| 66 | 110079 | 杭银转债 | 2,300,296.44 | 0.22 |
| 67 | 128066 | 亚泰转债 | 2,261,953.53 | 0.22 |
| 68 | 113657 | 再22转债 | 2,194,616.44 | 0.21 |
| 69 | 113641 | 华友转债 | 2,181,426.85 | 0.21 |
| 70 | 113609 | 永安转债 | 2,161,260.00 | 0.21 |
| 71 | 128133 | 奇正转债 | 2,150,807.40 | 0.21 |
| 72 | 113626 | 伯特转债 | 2,119,520.40 | 0.20 |
| 73 | 128081 | 海亮转债 | 1,913,247.95 | 0.18 |
| 74 | 123133 | 佩蒂转债 | 1,887,698.85 | 0.18 |
| 75 | 113542 | 好客转债 | 1,706,971.23 | 0.16 |
| 76 | 123129 | 锦鸡转债 | 1,632,828.00 | 0.16 |
| 77 | 110043 | 无锡转债 | 1,443,320.26 | 0.14 |
| 78 | 127054 | 双箭转债 | 1,290,334.25 | 0.12 |
| 79 | 123063 | 大禹转债 | 1,211,265.20 | 0.12 |
| 80 | 113659 | 莱克转债 | 1,178,809.59 | 0.11 |
| 81 | 123169 | 正海转债 | 902,556.93 | 0.09 |
| 82 | 113048 | 晶科转债 | 682,925.94 | 0.07 |
| 83 | 127053 | 豪美转债 | 432,424.19 | 0.04 |
| 84 | 128120 | 联诚转债 | 427,424.98 | 0.04 |
| 85 | 127070 | 大中转债 | 370,919.37 | 0.04 |
| 86 | 113598 | 法兰转债 | 365,019.77 | 0.03 |
| 87 | 113058 | 友发转债 | 225,020.81 | 0.02 |
| 88 | 123099 | 普利转债 | 170,831.90 | 0.02 |
| 89 | 113619 | 世运转债 | 81,285.79 | 0.01 |
| 90 | 118018 | 瑞科转债 | 17,437.34 | 0.00 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 974,760,127.88 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 9,864,975.53 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 106,852,286.98 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 877,772,816.43 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 42,458,331.97 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | — |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | — |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 42,458,331.97 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 4.84 |

注：买入/申购含红利再投资、转换入份额；卖出/赎回含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金的管理人未运用固有资金申赎及买卖本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立富国天丰强化收益债券型证券投资基金的文件
- 2、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金合同
- 3、富国天丰强化收益债券型证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件
- 5、富国天丰强化收益债券型证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1196 号世纪汇办公楼二座 27-30 层

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。
咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费）公司网址：
<http://www.fullgoal.com.cn>。

富国基金管理有限公司
2023 年 07 月 21 日